

Социально-экономический прогноз как механизм стратегического управления экономикой



Александр Александрович ШИРОВ, заместитель директора Института народнохозяйственного прогнозирования РАН

Любой экономический расчет, пусть даже самый совершенный, не может носить характер абсолютного доказательства. Тем не менее наличие качественного экономического прогноза — неотъемлемого элемента системы управления экономическим развитием — очень важно, поскольку именно в рамках прогнозных расчетов могут быть получены количественные оценки последствий тех или иных действий.

Наличие большого количества прямых и обратных связей в современной экономике требует достаточно сложных расчетов, использования специальных эконометрических моделей. Однако все эти трудности при разработке прогноза перекрываются той дополнительной информацией, которая может быть важным аргументом при принятии решения.

КАК СФОРМИРОВАТЬ ПРОГНОЗ

Низкие темпы роста в российской экономике, отсутствие устойчивого тренда на восстановление экономических показателей после финансово-экономического кризиса 2014–2015 годов диктуют неизбежность изменения

параметров экономической политики для интенсификации экономического развития. Требования к количественным и качественным изменениям в российской экономике были сформулированы в послании Президента РФ Федеральному собранию РФ и в президентском указе № 204.

И совершенно не случайно, что наряду с другими действиями, направленными на реализацию положений этих стратегических документов, Председатель Правительства РФ поручил Министерству экономического развития РФ разработать прогноз на период до 2024 года, обеспечивающий достижение национальных целей развития Российской Федерации. В логике этих решений прогноз выполняет однозначную функцию обоснования набора мер экономической политики, способных обеспечить достижение выбранных ориентиров стратегического развития страны.

Задачу формирования социально-экономического прогноза на уровне страны можно решать разными способами. Например, можно пытаться тиражировать подходы к прогнозированию, используемые в других странах. Так как система официальной статистики в России и других ведущих странах гармонизирована, то такой подход вполне можно рассмотреть. Однако проблема в том, что в отличие от ряда развитых стран российская экономика все еще находится на стадии существенной трансформации, обладает серьезной спецификой, а импортируемые готовые решения не всегда бывают эффективными. Кроме того, нужно отметить, что заимствуются, как правило, не самые современные подходы, что приводит к сохранению отставания уровня прогнозно-аналитических расчетов в нашей стране от лучших мировых практик.

Другой путь при формировании расчетов состоит в создании инструментов и методологии прогнозирования, опирающейся на специфические особенности функционирования российской экономики. Но прежде чем это делать, было бы полезно ответить на ряд «простых» вопросов:

что изменилось в факторах роста российской экономики;

какая экономическая политика формируется и нуждается в обосновании;

какая информация требуется для формирования прогноза;

какие инструменты приемлемы для формирования прогноза;

каково место прогноза в структуре принятия решений?

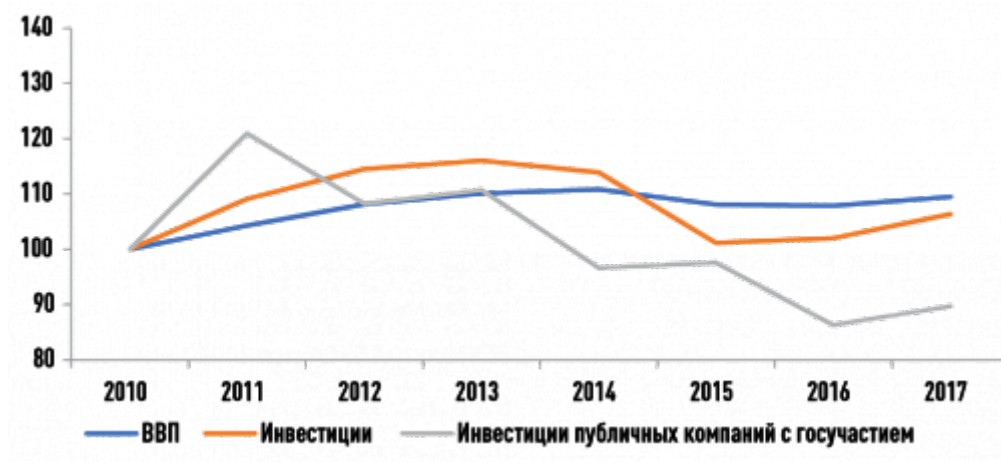


Рисунок 1. Динамика ВВП и инвестиций в основной капитал, 2010 г. = 100%

РОССИЙСКИЕ РЕАЛИИ

Если рассмотреть текущую экономическую динамику, то можно отметить отчетливую тенденцию к сохранению низких темпов экономического роста в нашей стране. Достаточно сказать, что за период 2008–2017 годов совокупный рост ВВП составил всего 4%. Решающее значение в замедлении темпов экономического роста внесли ограничения на наращивание доходов от российского сырьевого комплекса. Он уже не может быть единственным локомотивом роста. Набор конкурентоспособных секторов экономики не позволяет обеспечивать динамичное развитие стране, которая по объему ВВП уже превысила позднесоветские показатели.

Низкий уровень технологического развития базовых секторов промышленности формирует избыточную зависимость от импорта, требует периодических циклов ослабления курса рубля. Экономика нуждается в новых факторах роста, новых источниках доходов. Задачи развития экономики в той или иной степени предполагают задействование внутренних источников роста, рост инвестиционной активности, эффективности и конкурентоспособности базовых секторов промышленности, расширение несырьевого экспорта. Соответственно, современная система социально-экономического прогнозирования должна быть ориентирована на описание взаимодействий в рамках формирования новых источников ускорения экономической динамики.

В связи с этим хотелось бы сказать о том, что сейчас в российской практике экономического анализа наблюдается устойчивый дефицит работ, связанных с анализом структурных особенностей экономики, существующих механизмов межотраслевых взаимодействий, их влияния на экономическую динамику. Особенно важными такие исследования могут быть в части влияния развития технологий на финансово-экономические показатели отдельных видов деятельности.

ПРОИЗВОДСТВЕННАЯ СТРУКТУРА ЭКОНОМИКИ

Изменение структуры производства, механизмов формирования доходов, ценовых пропорций будет определять экономическую динамику российской экономики в обозримой перспективе. Тенденция формирования экономической динамики под воздействием структурных сдвигов постепенно становится глобальной. В течение ряда лет развитые страны обеспечивали экономический рост через использование технологической ренты, вынося трудо- и материалоемкие производства в развивающиеся страны. Происходило облегчение производственной структуры ведущих стран. Возникла концепция постиндустриального общества.

Однако любой процесс имеет пределы. Снижение доли базовой промышленности в структуре формирования ВВП негативно влияет как на уровень занятости населения, так и на его доходы. Доля доходов, находящихся в распоряжении транснациональных корпораций, становится неприемлемой даже для развитых стран. В этих условиях современная реиндустриализация развитых стран стала одним из ключевых элементов современной экономической повестки.



Рисунок 2. Темпы роста ВВП в 2019–2024 гг., %

Все сказанное означает, что для формирования комплексных прогнозов социально-экономического развития как в России, так и в большинстве крупных стран в ближайшие годы потребуются детальное рассмотрение процессов на уровне производственной структуры экономики, ее взаимодействия с технологическими факторами, механизмами формирования кооперационных связей, вовлеченностью в глобальные цепочки создания добавленной стоимости. Необходимо использовать инструменты, позволяющие комплексно оценивать совокупность динамических и структурных характеристик современной российской экономики. Решение данной задачи на современном уровне развития экономической науки и статистики практически невозможно без использования методологии «затраты – выпуск», которая получила новый импульс в рамках развития современных методов анализа и прогнозирования во многих крупнейших странах мира. Имеется существенный потенциал развития методологии прогнозных расчетов, описывающих поведение экономических агентов.

КТО ВЛАДЕЕТ ИНФОРМАЦИЕЙ...

Для подробного макроструктурного анализа и прогнозирования необходима информация. В принципиальном плане наличие информации отличает те аспекты экономической динамики, которые можно количественно оценить, и те, о которых можно рассуждать исключительно на качественном уровне. Современное развитие информационных технологий и цифровизация позволяют существенно расширить объем доступной экспертному сообществу информации, повысить качество как официальной, так и корпоративной статистики.

С точки зрения эволюции системы статистического наблюдения за экономическими процессами существует несколько важных направлений. Первое — расширение механизмов распространения данных в рамках глобальных платформ обмена информацией. Второе — обеспечение доступа к данным, собираемым различными министерствами и ведомствами, их систематизация и анализ. Третье — использование возможностей работы с массивами данных big data. Все эти направления должны существенно повысить качество и достоверность используемых статистических данных, а значит, и обоснованность выводов, сделанных на их основе.

Однако для реального совершенствования информационного обеспечения прогнозных расчетов стратегического характера необходимо проделать большую методическую работу по гармонизации новых механизмов сбора и обработки данных с базовыми принципами системы национальных счетов. В российской практике наиболее актуальным направлением развития статистического обеспечения прогнозно-аналитических расчетов можно рассматривать расширение масштабов ведомственного сбора и первичной обработки данных. Прежде всего такими ведомствами, как Федеральная налоговая служба, Федеральная таможенная служба, Пенсионный фонд и т. д. При этом непосредственно Росстату было бы целесообразно вернуть ряд аналитических функций, позволяющих не просто собирать и предоставлять данные в конечном виде, но и трактовать их с учетом фактической ситуации в экономике. Не секрет, что ряд ошибок при анализе экономической динамики связан с банальным непониманием методологии формирования данных и происходящих в ней изменений.

ПРОГНОЗ КАК ИНСТРУМЕНТ ОБОСНОВАНИЯ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ

Так как макроэкономический прогноз — это прежде всего инструмент обоснования экономической политики, он должен быть ориентирован на принципы ее формирования. Регулярная экономическая политика предполагает выстраивание такой конфигурации параметров денежно-кредитной, налоговой, тарифной и других политик, которая обеспечит устойчивое развитие экономики как минимум в среднесрочной перспективе. Внося отдельные изменения в те или иные параметры регулярной экономической политики, ее можно настраивать в соответствии с теми или иными изменениями экономической конъюнктуры. Например, смягчение или ужесточение параметров денежно-кредитной политики путем изменения процентной ставки может рассматриваться как один из примеров действий в области регулярной экономической политики.

Если исходить из того, что экономика может эффективно управляться действиями в области регулярной экономической политики, то приоритет при прогнозно-аналитическом сопровождении управления экономикой вполне может быть отдан агрегированным макроэкономическим моделям. При понимании того, как отреагируют на изменение процентных ставок или курса рубля агрегированные макроэкономические индикаторы (ВВП,

промышленное производство, инфляция), можно строить систему оценки эффективности действий, используя инструментарий, базирующийся на обобщенном описании экономических процессов.

Но если говорить о текущей ситуации в российской экономике, то следует признать наличие массы структурных проблем и дисбалансов, которые резко снижают эффективность мероприятий регулярной экономической политики. Основные из этих дисбалансов связаны с неэффективным распределением ресурсов между видами экономической деятельности и уровнями экономической системы, технологическим отставанием ряда производств и т. д. Например, тяжелое финансово-экономическое положение ряда производств, ориентированных на внутренний спрос, делает малоэффективными с точки зрения расширения заемного кредитования действия по снижению ключевой ставки.

ИНВЕСТИЦИОННАЯ ПАУЗА

Важно отметить и тот факт, что в российской экономике сформировались крайне неблагоприятные условия для расширения уровня инвестиционной активности. Инвестиционная пауза наступила как у крупнейших российских сырьевых компаний, так и у публичных компаний с государственным участием. Инвестиции публичных компаний с государственным участием все еще примерно на 10–15% ниже докризисного уровня (рисунок 1). У сырьевых компаний вроде бы есть необходимые финансовые ресурсы, но нет достойных целей для инвестирования.

Значительные инвестиции в производственные мощности, ориентированные на внутренний спрос, были сделаны в сфере нефтепереработки, металлургии, химической промышленности, изготовления строительных материалов. К сожалению, в условиях низких темпов роста инвестиций в основной капитал эти мощности пока используются достаточно слабо. На этом фоне у финансово благополучных компаний возникает мотив к увеличению дивидендных выплат. В целом по российским публичным компаниям отношение дивидендных выплат к капитальным затратам превысило 60%, а для ряда металлургических компаний составило свыше 100%.

Соответственно, анализ расширения уровня инвестиционной активности, возможности задействования имеющихся производственных мощностей для роста экономики должен производиться как минимум на уровне секторов экономики, а возможно, и на уровне отдельных производств.

НАЦИОНАЛЬНЫЕ ПРОЕКТЫ: ЭФФЕКТИВНОСТЬ ПОД ВОПРОСОМ?

Основным инструментом достижения целей экономического развития, обозначенных в указе президента № 204, являются национальные проекты. Они по своей сути являются элементом селективной экономической политики,

направленной на то, чтобы устранить имеющиеся в экономике дисбалансы и обеспечить большую эффективность мер регулярной экономической политики. Их задача — обеспечить постепенный переход к новому качеству экономического роста, предполагающему большую устойчивость и независимость от колебаний внешнеэкономической конъюнктуры.

В то же время понятно, что риски формирования и реализации экономической политики через набор таких проектов существуют и они достаточно высоки. Прежде всего они связаны с тем, что средства будут потрачены с достаточно низким макроэкономическим эффектом, а усилия государства не будут поддержаны частным сектором. В связи с этим возникает крайне актуальная задача оценки макроэкономической эффективности национальных проектов как в отдельности, так и с учетом их совокупного влияния на экономическую динамику. Такая работа требует расширения методов макроструктурного анализа и прогнозирования, обеспечивающих взаимную увязку механизмов финансирования отдельных проектов и их отраслевую специфику с ключевыми параметрами регулярной экономической политики и фактической структурой отечественной экономики.



Рисунок 3. Возможная конфигурация системы прогнозирования и оценки рисков экономического развития

Имеющаяся информация о конкретном наполнении национальных проектов позволяет говорить о том, что их мероприятия будут воздействовать на развитие отдельных видов деятельности, масштаб и качество межотраслевых связей в экономике, задействует механизм взаимоотношений бизнеса и государства, отразится на пространственном развитии экономики. Соответственно, система анализа и прогнозирования, направленная на оценку макроэкономической эффективности национальных проектов, должна учитывать все эти аспекты. Речь идет о достаточно сложной системе количественных оценок, позволяющей переходить от показателей расходов бюджета к параметрам изменения производства и инвестиций, зарплат, налогов, прибыли и т. д. Очевидно, что должны учитываться не только прямые, но и косвенные эффекты от реализации таких крупных и важных для экономики проектов, и не только в рамках одного года, но и в динамике.

Оценка эффективности государственных затрат является лишь одним из элементов, формирующих экономическую динамику. Соответственно, национальные проекты должны быть погружены в единый макроэкономический сценарий, демонстрирующий возможность достижения целевых ориентиров развития с учетом вклада в экономическую динамику усилий бизнеса, государства и населения.

Например, наши расчеты показывают, что среднегодовые темпы роста ВВП свыше 3% в 2019–2024 годах достижимы при увеличении нормы накопления к 2024 году до уровня 27%. При этом в силу ограничений финансового характера бюджетное финансирование необходимых дополнительных инвестиций, прежде всего в рамках национальных проектов, не может превышать 35%. Иначе говоря, влияние национальных проектов в их текущем виде на экономический рост будет достаточно ограниченным.

УСЛОВИЯ ДЛЯ ИНВЕСТИЦИЙ

В этих условиях возрастают требования к финансированию инвестиций за счет собственных средств предприятий и заемных источников (рисунок 2). Так, доля банковских кредитов нефинансовым предприятиям в ВВП, по нашим оценкам, должна вырасти с 42 до 56%, а вклад этого источника в рост инвестиций достичь 40%. Несмотря на рост объемов финансирования инвестиций за счет коммерческого кредитования и бюджета, собственные средства предприятий должны стать ключевым источником на фазе ускорения экономического роста. Соответственно, определяющим элементом текущей экономической политики должно стать формирование условий для трансформации предпринимательских доходов в инвестиции в основной капитал. Это означает необходимость мер экономической политики, направленных на ограничение роста издержек на первичные ресурсы, стабилизацию уровня налоговых и административных платежей и т. д.

Комплексный анализ перспективной экономической динамики также показывает, что при условии задействования потенциала частного бизнеса наращивание бюджетных расходов инвестиционного характера и расширение кредитования практически полностью обеспечиваются дополнительными доходами, возникающими в результате экономического роста. Это означает, что у государства появляется возможность более свободно маневрировать ресурсами, обеспечивая их перераспределение на иные направления расходов, повышая таким образом темпы экономического роста.

РУТИННЫЙ АНАЛИЗ

К сожалению, разработка национальных проектов на первом этапе не сопровождалась необходимой оценкой их вклада в экономическую динамику как на уровне отдельных проектов, так и в целом. Произошло это, по-видимому, из-за того, что у разработчиков этих крупных программ был очевидный дефицит времени. Но есть и еще одна причина, которая носит фундаментальный характер. К сожалению, в нашей стране не существует выстроенной системы рутинного анализа и прогнозирования, использующего ресурсы органов государственной власти и экспертного сообщества, встроенной в контур принятия экономических решений. Официальный социально-

экономический прогноз как инструмент обоснования экономической политики постепенно утратил свои функции. Превратился, по сути, в один из вспомогательных инструментов бюджетной политики. На наш взгляд, такое положение дел является нетерпимым.

Очевидно, что обоснование стратегии развития экономики требует рассмотрения факторов роста в кратко-, средне- и долгосрочной перспективе с учетом различных рисков (рисунок 3). Если мы говорим о краткосрочной перспективе, то это прежде всего риски, связанные с экономической конъюнктурой и финансовыми показателями. При оценке долгосрочных факторов роста во внимание должны приниматься параметры демографического развития, изменения технологий, взаимоотношения между странами и регионами. Для столь разных задач должен использоваться соответствующий инструментарий, позволяющий согласовывать оценки на разных временных горизонтах, нацеленный на оценку последствий всего диапазона решений в области управления экономикой.

В наиболее тяжелом состоянии в нашей стране находятся вопросы обоснования решений в области пространственного развития экономики. Фактически культура комплексного согласования макроэкономических и региональных прогнозных расчетов, учитывающих влияние межрегиональных и межотраслевых связей, утрачена, несмотря на то что у нашей страны имелись существенные заделы и результаты в этой области. Этот сегмент национальной системы стратегического анализа и прогнозирования придется практически полностью воссоздавать.

В целом задача формирования единой прогнозно-аналитической системы сопровождения стратегических решений в области управления экономикой превращается в одно из ключевых направлений совершенствования механизмов государственного управления, ориентированных на устойчивое развитие экономики в долгосрочной перспективе. Создание такой системы в достаточно сжатые сроки не представляется нам невыполнимой задачей.